

**HSBC Portföy Yönetimi**  
**Serbest Fonlara İlişkin Aylık Risk Bildirim Raporu**  
**Eylül 2019**

HSBC Portföy Yönetimi'nin kurucusu olduğu serbest fonlara ilişkin eylül ayı serbest fon risk bildirim raporu aşağıdadır.

Tüm serbest fonlar 02/09/2019 - 30/09/2019 tarihleri arasında kaldıraç seviyeleri ve belirlenen risk limitleri ile uyumludur.

| Fon Kodu | Fon Adı                                  | RMD (%)<br>(1) | Kaldıraç Oranı (%)<br>(2) | Kaldıraç Limiti (%)<br>(3) |
|----------|--|----------------|---------------------------|----------------------------|
| HDB      | Hsbc Portföy Birinci Serbest (Döviz) Fon | 1.90%          | 0.00%                     | 500%                       |

\*30/09/2019 değerleri kullanılmıştır.

**Açıklamalar**

1)RMD (%): Riske maruz değer, fon portföy değerinin normal piyasa koşulları altında ve belirli bir dönem dahilinde maruz kalabileceği en yüksek zararı belirli bir güven aralığında (Hesaplamalarda tek taraflı %99 olarak alınmıştır.) ifade eden orandır.

2)Kaldıraç Oranı (%): Kaldıraç yaratan işlemlere ilişkin olarak araç bazında ayrı ayrı hesaplanan pozisyonların mutlak değerlerinin toplanması (sum of notionals) suretiyle ulaşılan toplam pozisyonun fon toplam değerine oranını ifade eder.

3)Kaldıraç Limiti (%): HSBC Portföy Yönetimi tarafından belirlenen ve fonun izahnamesinde belirtilen kaldıraç limitidir.